

Raport roczny struktura aktywów na dzień 31.12.2005

L.p.	PORTFEL INWESTYCYJNY	Wyszczególnienie	Liczba papierów wartościowych	Wartość na dzień wyceny	Udział w aktywach
I.	Papiery wartościowe dopuszczone do obrotu publicznego:	Suma		3,010,862,816.26	95.60%
1	Akcje spółek notowanych na rynkach giełdowych	Suma		999,656,645.71	31.74%
1.1		Suma		999,656,645.71	31.74%
		<i>Agora S.A.</i>	245,689	17,141,721.53	0.54%
		<i>Amrest Holdings N.V.</i>	88,571	3,271,812.74	0.10%
		<i>Bank Austria Creditanstalt.AG</i>	7,862	2,760,741.30	0.09%
		<i>Bank BPH S.A.</i>	52,558	39,259,774.84	1.25%
		<i>Bank Polska Kasa Opieki S.A.</i>	516,686	90,523,387.20	2.87%
		<i>Bank Zachodni WBK S.A.</i>	169,862	23,814,652.40	0.76%
		<i>Barlinek S.A.</i>	336,300	2,915,721.00	0.09%
		<i>BRE Bank S.A.</i>	78,764	13,278,035.12	0.42%
		<i>Budimex S.A.</i>	80,884	3,090,577.64	0.10%
		<i>Cersanit S.A.</i>	1,572,306	22,138,068.48	0.70%
		<i>Comarch S.A.</i>	190,466	12,210,775.26	0.39%
		<i>Computerland S.A.</i>	35,240	3,263,224.00	0.10%
		<i>Echo Investment S.A.</i>	92,820	14,456,715.00	0.46%
		<i>Elektrodubowa S.A.</i>	87,629	3,233,510.10	0.10%
		<i>Elstar Olis S.A.</i>	118,136	8,303,779.44	0.26%
		<i>EMAX S.A.</i>	39,406	3,901,194.00	0.12%
		<i>Farmacol S.A.</i>	359,024	14,468,667.20	0.46%
		<i>Firma Oponiarska Dębica S.A.</i>	219,990	14,193,754.80	0.45%
		<i>Globe Trade Cente S.A.</i>	123,994	21,426,163.20	0.68%
		<i>Grupa Kęty S.A.</i>	160,431	20,270,456.85	0.64%
		<i>Grupa LOTOS S.A.</i>	221,000	9,830,080.00	0.31%
		<i>Grupa Żywiec S.A.</i>	9,995	4,821,687.95	0.15%
		<i>ING Bank Śląski S.A.</i>	92,007	51,628,807.98	1.64%
		<i>Inter Cars S.A.</i>	99,779	2,377,733.57	0.08%
		<i>Inter Groclin Auto S.A.</i>	213,004	13,404,341.72	0.43%
		<i>Ivax Corporation</i>	72,624	7,568,873.28	0.24%
		<i>JC AUTO S.A.</i>	100,420	3,745,666.00	0.12%
		<i>Jelfa S.A.</i>	61,809	4,647,418.71	0.15%
		<i>Jutrzenka S.A.</i>	77,072	6,665,957.28	0.21%
		<i>KGHM Polska Miedź S.A.</i>	708,399	44,310,357.45	1.41%
		<i>Kredyt Bank S.A.</i>	868,462	12,201,891.10	0.39%
		<i>LPP. S.A.</i>	13,125	10,065,168.75	0.32%
		<i>Mol Magyar Olaj - Es Gazipari Reszvenytarsasag</i>	27,351	8,209,129.14	0.26%
		<i>Mondi Packaging Paper Świecie S.A.</i>	139,681	7,118,143.76	0.23%
		<i>National Savings and Commercial Bank Ltd</i>	70,540	7,556,672.63	0.24%
		<i>Netia S.A.</i>	1,691,860	9,677,439.20	0.31%
		<i>Opoczno S.A.</i>	252,190	9,086,405.70	0.29%
		<i>Orbis S.A.</i>	155,330	5,113,463.60	0.16%
		<i>Pfleiderer Grajewo S.A.</i>	374,054	13,428,538.60	0.43%
		<i>Polcorolit S.A.</i>	1,164,629	2,923,218.79	0.09%
		<i>Polimex - Mostostal Siedlce S.A.</i>	115,244	7,190,073.16	0.23%
		<i>Polska Grupa Farmaceutyczna S.A.</i>	173,539	10,466,137.09	0.33%
		<i>Polski Koncern Mięсны DUDA S.A.</i>	405,258	4,380,838.98	0.14%
		<i>Polski Koncern Naftowy Orlen S.A.</i>	2,243,394	140,167,257.12	4.45%

		<i>Polskie Górnictwo i Gazownictwo S.A.</i>	8,652,755	30,111,587.40	0.96%
		<i>Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.</i>	3,111,405	90,324,087.15	2.87%
		<i>Prokom Software S.A.</i>	23,783	3,270,162.50	0.10%
		<i>Sanockie Zakłady Przemysłu Gumowego Stomil Sanok S.A.</i>	44,102	5,868,653.14	0.19%
		<i>Telekomunikacja Polska S.A.</i>	4,735,516	111,142,560.52	3.53%
		<i>TVN S.A.</i>	251,126	19,786,217.54	0.63%
		<i>Zakłady Azotowe PUŁAWY S.A.</i>	51,390	2,796,643.80	0.09%
		<i>Zespół Elektrociepłowni Wrocławskich Kogeneracja S.A.</i>	130,000	5,848,700.00	0.19%
9	Obligacje	Suma		2,011,206,170.55	63.86%
9.1	skarbowe	Suma		2,011,206,170.55	63.86%
		<i>DK0809</i>	43,000	45,542,590.00	1.45%
		<i>DS0509</i>	260,000	278,597,800.00	8.85%
		<i>DS1013</i>	60,292	60,546,432.24	1.92%
		<i>DS1015</i>	60,000	65,882,400.00	2.09%
		<i>DS1110</i>	115,000	120,621,200.00	3.83%
		<i>DZ0109</i>	20,000	22,054,000.00	0.70%
		<i>DZ0110</i>	31,797	35,275,273.83	1.12%
		<i>DZ0708</i>	11,990	12,605,806.40	0.40%
		<i>DZ0709</i>	8,420	8,915,601.20	0.28%
		<i>DZ1111</i>	97,216	97,147,948.80	3.08%
		<i>OK0407</i>	200,000	189,020,000.00	6.00%
		<i>OK0807</i>	240,000	223,296,000.00	7.09%
		<i>OK1207</i>	255,000	233,784,000.00	7.42%
		<i>PS0206</i>	35,000	37,869,650.00	1.20%
		<i>PS0310</i>	224,088	240,585,358.56	7.64%
		<i>PS0507</i>	55,000	60,756,300.00	1.93%
		<i>PS0608</i>	264,344	278,705,809.52	8.85%
II.	Papiery wartościowe niedopuszczone do obrotu publicznego:	Suma		30,098,430.00	0.96%
14	Obligacje	Suma		30,098,430.00	0.96%
14.3	niezabezpieczonych obligacjach innych podmiotów	Suma		30,098,430.00	0.96%
		Żywiec 060306	3,000	30,098,430.00	0.96%
IV.	Depozyty bankowe i bankowe papiery wartościowe w walucie polskiej	Suma		93,783,160.58	2.98%
	RCBW	DB201205	1	49,374,850.00	1.57%
	BHWK	DP301205	1	44,408,310.58	1.41%
POZOSTAŁE SKŁADNIKI AKTYWÓW				14,603,523.15	0.46%
AKTYWA			RAZEM	3,149,347,929.99	100.00%

Na pozostałe składniki aktywów składają się środki pieniężne i należności
 Rozbieżności w sumach wynikają z zaokrągleń systemowych



Grzegorz Chojnacki
 Kierownik Zespołu Kontroli Realizacji Polityki Inwestycyjnej
 Sampo PTE S.A.